

东方红沪港深灵活配置混合型  
证券投资基金招募说明书（更新）  
（2022年第1号）

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇二二年三月十一日

## 【重要提示】

东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请经中国证监会2015年11月19日证监许可【2015】2666号文准予注册。本基金的基金合同于2016年7月11日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同和基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,自行承担投资风险。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险、本基金特有的风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“卖者尽责、买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本基金除了投资 A 股外,还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市 的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动

风险等一般投资风险之外，本基金还会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

**基金管理人在此特别提示投资者：**基金名称仅表明本基金可以通过港股通机制投资港股，基金资产对港股标的投资比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整，存在不对港股进行投资的可能。

本基金投资于中小企业私募债券，由于中小企业私募债券采取非公开发行的方式发行，即使在市场流动性比较好的情况下，个别债券的流动性可能较差，从而使得基金在进行个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对价格产生比较大的影响，增加个券的建仓成本或变现成本。并且，中小企业私募债券信用等级较一般债券较低，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险，此外，当发行人信用评级降低时，基金所投资的债券可能面临价格下跌风险。

本基金可投资于科创板股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于股价波动风险、退市风险、流动性风险、投资集中风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于科创板或选择不将基金资

产投资于科创板，基金资产并非必然投资于科创板。

本基金可投资国内依法发行上市的存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外交易机制相关的风险可能直接或间接成为本基金风险。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然投资存托凭证。

本基金可投资北京证券交易所（以下简称北交所）股票，北交所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异。基金投资北交所股票，将面临因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于上市公司经营风险、股价波动风险、流动性风险、退市风险、投资集中风险、转板风险、监管规则变化的风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票，基金资产并非必然投资于北交所股票。

具体风险揭示烦请查阅本基金招募说明书“风险揭示”章节内容。

本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本招募说明书基金投资组合报告和基金业绩表现截止至2021年12月31日（财务数据未经审计），其余所载内容截止至2022年3月3日。

# 目录

一、绪言.....	6
二、释义.....	7
三、基金管理人.....	12
四、基金托管人.....	22
五、相关服务机构.....	27
六、基金的募集.....	38
七、基金合同的生效.....	39
八、基金份额的申购、赎回与转换.....	40
九、基金的投资.....	52
十、基金的业绩.....	66
十一、基金的财产.....	68
十二、基金资产的估值.....	69
十三、基金的收益与分配.....	78
十四、基金的费用与税收.....	80
十五、基金的会计与审计.....	85
十六、基金的信息披露.....	86
十七、风险揭示.....	93
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	106
十九、基金合同内容摘要.....	108
二十、托管协议的内容摘要.....	125
二十一、对基金份额持有人的服务.....	141
二十二、其他应披露事项.....	143
二十三、招募说明书的存放及查阅方式.....	146
二十四、备查文件.....	147

# 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了本基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由上海东方证券资产管理有限公司解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。招募说明书主要向投资者披露与本基金相关事项的信息，是投资者据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、**基金或本基金**：指东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金
- 2、**基金管理人**：指上海东方证券资产管理有限公司
- 3、**基金托管人**：指中国工商银行股份有限公司
- 4、**基金合同、《基金合同》**：指《东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效的修订和补充
- 5、**托管协议**：指基金管理人与基金托管人签订的《东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
- 6、**招募说明书或本招募说明书**：指《东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、**基金产品资料概要**：指《东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、**基金份额发售公告**：指《东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、**法律法规**：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件及其制定机构所作出的修订、补充和有权解释
- 10、**《基金法》**：指自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、**《销售办法》**：指自2013年6月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、**《信息披露办法》**：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、**《运作办法》**：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、**《流动性风险管理规定》**：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关



对其不时做出的修订

15、**中国证监会**：指中国证券监督管理委员会

16、**银行业监督管理机构**：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

17、**基金合同当事人**：指受基金合同约定，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

18、**个人投资人**：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

19、**机构投资者**：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中国合法登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织

20、**合格境外机构投资者**：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、**投资人**：指个人投资人、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的总称

22、**基金份额持有人**：指根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资人

23、**基金销售业务**：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、**销售机构、代销机构**：指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，代为办理基金销售业务的机构

25、**登记业务**：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

26、**基金登记机构**：指上海东方证券资产管理有限公司或其委托的符合条件的办理基金登记业务的机构

27、**基金账户**：指基金登记机构给投资人开立的用于记录投资人持有基金管

理人管理的证券投资基金份额情况的账户

28、**基金交易账户**：指各销售机构为投资人开立的记录投资人通过该销售机构办理基金认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务所引起的基金份额的变动及结余情况的账户

29、**基金合同生效日**：指基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日

30、**基金合同终止日**：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

31、**募集期**：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

32、**基金存续期**：指《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间

33、**工作日**：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

34、**T日**：指申购、赎回或办理其他基金业务的申请日

35、**T+n日**：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

36、**开放日**：指销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日（若该工作日为非港股通交易日，则本基金不开放）

37、**开放时间**：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

38、**《业务规则》**：指《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划份额登记及资金结算业务指南》以及其他适用于证券投资基金的业务规则

39、**认购**：指在本基金募集期内投资人根据基金合同和招募说明书的规定购买本基金基金份额的行为

40、**申购**：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、**赎回**：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额转换为现金的行为

42、**基金转换**：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金

管理人管理的其他基金基金份额的行为

43、**转托管**：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

44、**定期定额投资计划**：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

45、**巨额赎回**：指在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的10%时的情形

46、**元**：指中国法定货币人民币元

47、**基金收益**：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

48、**基金资产总值**：指基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和

49、**基金资产净值**：指基金资产总值扣除负债后的净资产值

50、**基金份额净值**：指估值日基金资产净值除以估值日基金份额总数的数值

51、**基金资产估值**：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

52、**指定媒介**：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

53、**不可抗力**：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

54、**基金销售网点**：指基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点

55、**货币市场工具**：指现金；一年以内（含一年）的银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具

56、**港股通**：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所、深圳证券交易所或经证监会认可的机构设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市股票

57、**流动性受限资产**：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

58、**摆动定价机制**：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资人，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

## 三、基金管理人

### （一）基金管理人概况

本基金基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基本信息如下：

名称：上海东方证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路109号7层-11层

办公地址：上海市黄浦区外马路108号供销大厦7层-11层

法定代表人：宋雪枫

设立日期：2010年7月28日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2010]518号

开展公开募集证券投资基金业务批准文号：证监许可[2013]1131号

组织形式：有限责任公司

注册资本：3亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：（021）53952888

联系人：彭轶君

股东情况：东方证券股份有限公司持有公司100%的股权。

公司前身是东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部，2010年7月28日经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518号）批准，由东方证券股份有限公司出资3亿元，在原东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部的基础上正式成立，是国内首家获批设立的券商系资产管理公司。

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

宋雪枫先生，董事长，中共党员，管理学博士。曾任申能股份有限公司投资部办事员，财务部办事员、主管、副经理、经理，总经理助理，总会计师，副总经理，监事长；上海外高桥第二发电有限责任公司财务总监、监事长；上海浦东发展银行股份有限公司监事；申能集团财务有限公司监事长；上海嘉禾航运有限公司董事长；中天合创能源有限责任公司监事长；申能（集团）有限公司总经理

助理；上海诚毅投资管理有限公司总经理、董事长；东方证券股份有限公司监事会主席；上海申能诚毅股权投资有限公司董事长；上海申能能创能源发展有限公司董事长。现任申能（集团）有限公司党委委员、副总裁，东方证券股份有限公司党委书记、执行董事，上海东方证券资产管理有限公司董事长。

杨斌先生，董事，中共党员，经济学硕士。曾任中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处科员，上海证管办稽查处、稽查局案件审理处副主任科员、主任科员，上海证监局稽查一处、机构二处主任科员、机构一处副处长、期货监管处处长、法制处处长，东方证券股份有限公司稽核总部总经理。现任东方证券股份有限公司副总裁兼首席风险官兼合规总监，上海东证期货有限公司董事、东方金融控股（香港）有限公司董事、东方证券承销保荐有限公司董事、上海东方证券创新投资有限公司董事、上海东方证券资产管理有限公司董事、长城基金管理有限公司监事。

张锋先生，董事、总经理，经济学硕士。曾任上海财政证券公司研究员，兴业证券股份有限公司研究员，上海融昌资产管理有限公司研究员，信诚基金管理有限公司股票投资副总监、基金经理，上海东方证券资产管理有限公司基金投资部总监、私募权益投资部总经理、公募集合权益投资部总经理、执行董事、董事总经理、副总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司董事、总经理、合规负责人兼首席风险官（代行）。

杨洁琼女士，董事，中共党员，法学学士。曾任东方证券股份有限公司人力资源管理总部高级主管、总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）。现任东方证券股份有限公司人力资源管理总部总经理兼党委办公室主任，上海东方证券资产管理有限公司董事，上海东证期货有限公司党委副书记。

尤文杰先生，董事，中共党员，经济学学士。曾任立信会计师事务所（特殊普通合伙）项目经理、高级经理、合伙人，东方证券股份有限公司计划财务管理总部副总经理、副总经理（主持工作）。现任东方证券股份有限公司计划财务管理总部总经理，上海东证期货有限公司董事、东方证券承销保荐有限公司董事、东方金融控股（香港）有限公司董事、上海东方证券资产管理有限公司董事。

## 2、基金管理人监事

朱静女士，监事，中共党员，经济学硕士。曾任西安矿山机械厂职员，上海

财通国际投资管理有限公司证券管理部经理、副总经理，东方证券股份有限公司经纪业务总部职员、业务规划董事、运行资深主管、总经理助理，营运管理总部总经理助理、副总经理，董事会办公室副主任。现任东方证券股份有限公司战略发展总部总经理兼工会办事机构主任、东方金融控股（香港）有限公司总经理，上海东证期货有限公司董事，东方金融控股（香港）有限公司董事，东证国际金融集团有限公司董事，长城基金管理有限公司董事，上海东方证券资产管理有限公司监事。

### 3、经营管理层人员

张锋先生，总经理（简历请参见上述关于董事的介绍）。

胡雅丽女士，联席总经理、财务负责人，中共党员，管理学硕士，《新财富》白金分析师。曾任招商证券研究发展中心分析师、中信证券研究部首席分析师（MD）、光大证券研究所所长、上海东方证券资产管理有限公司总经理助理。现任上海东方证券资产管理有限公司联席总经理、财务负责人兼任权益研究部总经理。

周代希先生，副总经理，中共党员，法学硕士。曾任深圳证券交易所会员管理部经理、金融创新实验室高级经理、固定收益与衍生品工作小组执行经理，兼任深圳仲裁委员会仲裁员。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理。

刘峰先生，副总经理，中共党员，经济学学士。曾任华福证券有限责任公司职员、兴业银行股份有限公司资产托管部职员、委托处副处长、委托处处长、总经理助理、副总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理，兼任智能客户服务部总经理。

汤琳女士，副总经理，管理学学士。曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部市场营销经理，上海东方证券资产管理有限公司综合管理部副总监、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理，兼任综合管理部总经理。

### 4、合规总监、首席风险官

张锋先生，合规总监兼首席风险官（代行）（简历请参见上述关于董事的介绍）。

### 5、公开募集基金管理业务合规负责人（督察长）

张锋先生，公开募集基金管理业务合规负责人（代行）（简历请参见上述关

于董事的介绍)。

## 6、本基金基金经理

### (1) 现任基金经理

秦绪文先生，上海东方证券资产管理有限公司公募权益投资部总经理、基金经理，2016年1月至2017年4月任东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2017年1月至今任东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金（原东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、2018年4月至今任东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2021年11月至今任东方红智选三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021年12月至今任东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。香港大学工商管理硕士。曾任平安证券有限公司证券研究所分析师，东方证券证券研究所董事、汽车行业分析师，上海东方证券资产管理有限公司行业研究员。

周杨先生，上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2019年6月至今任东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、2020年11月至今任东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2021年4月至今任东方红远见价值混合型证券投资基金基金经理。上海交通大学经济学硕士。曾任上海东方证券资产管理有限公司行业研究员。

### (2) 历任基金经理

刚登峰先生，2018年4月至2021年4月任东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

林鹏先生，2016年7月至2020年5月任东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

## 7、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员构成如下：主任委员张锋先生，委员胡雅丽女士，委员胡伟先生，委员邓炯鹏先生，委员谭鹏万先生，委员侯振新先生。

## 8、上述人员之间不存在近亲属关系。

### (三) 基金管理人的职责



1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关

资料15 年以上；

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### **（四）基金管理人关于遵守法律法规的承诺**

1、基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露管理办法》等法律法规的相关规定，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生；

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》，建立健全的内部

控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生：

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以提高自己；
- (10) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (11) 以不正当手段谋求业务发展；
- (12) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (13) 其他法律、行政法规和中国证监会规定禁止的行为。

**(五) 基金管理人关于禁止性行为的承诺**

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、违反规定向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资；
- 6、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 7、法律、行政法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

#### **（六）基金经理承诺**

- 1、依照有关法律法规和《基金合同》的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- 2、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- 3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### **（七）基金管理人的内部控制制度**

##### 1、内部控制的原则

（1）健全性原则。内部控制应当包括基金管理人的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

（3）独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金管理人基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

##### 2、内部控制的组织架构

基金管理人根据有关法律法规和章程的规定，建立了规范的治理机构和议事规则，明确了决策、执行、监督等方面的职责权限，形成了科学有效的职责分工

和制衡机制。董事会、监事、经营管理层能够根据公司章程以及有关议事规则运行并行使职权。

基金管理人设董事会，对股东负责。董事会有5名董事组成，设董事长1人。董事会下设合规与风险管理委员会。基金管理人已制定董事会议事规则，规定了董事会会议的召开及表决程序和职责等。

基金管理人设监事一名。公司监事依照法律及章程的规定负责检查财务和合规管理；对董事、总经理及其他高级管理人员执行职务时违反法律、法规或者章程的行为进行监督；督促落实风险管理体系的建立和实施及相关事项的整改；并就涉及基金管理人风险的重大事项向股东汇报。

经营管理层负责组织实施董事会决议，主持基金管理人的经营管理工作，负责经营管理中风险管理工作的日常运行。负责董事会授权范围内重大经营项目和创新业务的风险评估和决策。基金管理人已制定《上海东方证券资产管理有限公司总经理工作会议议事规则》，对公司总经理办公会议的种类及程序做出了明确规定。经营管理层下设投资决策委员会、产品委员会、风险控制委员会、信息技术战略发展和治理委员会，并分别制定了相应的议事规则，对各项重大业务及投资进行决策与风险控制。

### 3、内部控制制度

内部控制制度指规范内部控制的一系列规章制度和业务规则，是内部控制的重要组成部分。内部控制制度制订的基本依据为法律法规、中国证监会及其他主管部门有关文件的规定。内部控制制度分为四个层次：

(1) 《公司章程》——指经股东批准的《公司章程》，是基金管理人制定各项基本管理制度和具体管理规章的指导性文件；

(2) 内部控制大纲——是对《公司章程》规定的内部控制原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽；

(3) 公司基本管理制度——是基金管理人在经营管理宏观方面进行内部控制的制度依据。基本管理制度须经董事会审议并批准后实施。基本管理制度包括但不限于风险管理制度、投资管理制度、基金会计核算办法、信息披露办法、监察稽核制度、信息技术管理制度、业绩评估考核制度和危机处理制度等；

(4) 部门规章制度以及业务流程——部门规章制度以及业务流程是在公司

基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。它不仅是基金管理人的业务、管理、监督的需要，同时也是避免工作中主管随意性的有效手段。部门制度及具体管理规章根据总经理办公会的决定进行拟订、修改，经总经理办公会批准后实施的。制定的依据包括法律法规、证监会规定和《公司章程》及公司基本管理制度。

#### 4、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本基金管理人承诺以上内部控制的披露真实、准确。

(2) 本基金管理人承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

(3) 本基金管理人承诺将积极配合外部风险监督工作。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号  
成立时间：1984年1月1日  
法定代表人：陈四清  
注册资本：人民币35,640,625.7089万元  
联系电话：010-66105799  
联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至2021年12月，中国工商银行资产托管部共有员工214人，平均年龄34岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2021年12月，中国工商银行共托管证券投资基金1288只。自2003年以来，中国工商银行连续十八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的80项最佳托管银行大奖；是获得奖项最

多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从2005年至今共十四次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

##### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

##### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。



(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效

益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。中国工商银行通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管

部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### **（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序**

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 五、相关服务机构

### （一）基金销售机构

#### 1、直销机构

##### （1）直销中心

名称：上海东方证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路109号7层-11层

办公地址：上海市黄浦区外马路108号8层

法定代表人：宋雪枫

联系电话：（021）33315895

传真：（021）63326381

联系人：于莉

公司网址：www.dfham.com

##### （2）网上交易系统

网上交易系统包括基金管理人公司网站（www.dfham.com）、东方红资产管理APP、基金管理人微信服务号和基金管理人指定且授权的电子交易平台，个人投资者可登录基金管理人公司网站（www.dfham.com）、东方红资产管理APP、基金管理人微信服务号和基金管理人指定且授权的电子交易平台，在与本公司达成网上交易的相关协议、接受本公司有关服务条款、了解有关基金网上交易的具体业务规则后，通过本公司网上交易系统办理开户、申购、赎回等业务。

#### 2、代销机构

##### （1）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路119号东方证券大厦

办公地址：上海市中山南路318号2号楼13层、21层—23层、25层—29层、32层、36层、39层、40层

法定代表人：金文忠

客服电话：（021）95503

公司网站：www.dfzq.com.cn

##### （2）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层  
公司地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦  
法定代表人：其实  
客服电话：95021  
公司网站：<http://fund.eastmoney.com>

(3) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491  
办公地址：广州市海珠区阅江中路688号保利国际广场北塔33层  
法定代表人：肖雯  
客服电话：020-89629066  
公司网站：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(4) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层  
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦  
法定代表人：张纳沙  
客服电话：95536  
公司网站：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(5) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼  
办公地址：北京市东城区朝内大街188号  
法定代表人：王常青  
客服电话：4008888108  
公司网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(6) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安苑路11号西楼6层604、607  
办公地址：北京朝阳区北四环中路27号院5号楼A座6层11室  
法定代表人：闫振杰  
客服电话：4008188000  
公司网站：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(7) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区源深路1088号7层（实际楼层6层）

办公地址：上海市浦东新区源深路1088号平安财富大厦

法定代表人：陈祎彬

客服电话：400-821-9031

公司网站：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(8) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路501号6211单元

办公地址：上海市浦东新区张杨路500号华润时代广场12层

法定代表人：杨文斌

客服电话：4007009665

公司网站：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(9) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区知春路76号(写字楼)1号楼4层1-7-2

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部

法定代表人：邹保威

客服电话：95118

公司网站：<http://kenterui.jd.com>

(10) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区长阳路1687号2号楼

法定代表人：汪静波

客服电话：4008215399

公司网站：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(11) 上海东证期货有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路318号2号楼31层

办公地址：上海市黄浦区中山南路318号31层

法定代表人：卢大印

客服电话：400-885-9999

公司网站：www.dzqh.com.cn

(12) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路8号HALO广场一期4层12-13室

办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路8号HALO广场一期4层12-13室

法定代表人：薛峰

客服电话：4006788887

公司网站：www.zlfund.cn

(13) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：海南省三亚市天涯区三亚湾路国际客运港区国际养生度假中心酒店B座(2#楼)27楼2714室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期27层2716单元

法定代表人：张峰

客服电话：4000218850

公司网站：www.harvestwm.cn

(14) 北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层

办公地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼17层

法定代表人：李楠

客服电话：4001599288

公司网站：www.danjuanapp.com

(15) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座支付宝大楼

法定代表人：王珺

客服电话：4000766123

公司网站：www.fund123.cn

(16) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路1号903室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼4层

法定代表人：吴强

客服电话：952555

公司网站：www.5ifund.com

(17) 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室

办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室

法定代表人：梁蓉

客服电话：010-66154828

公司网站：www.5irich.com

(18) 腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区海天二路腾讯滨海大厦南塔15层

法定代表人：刘明军

客服电话：95017(拨通后转1转8)

公司网站：www.txfund.com

(19) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路500号30层3001单元

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

客服电话：4008205369

公司网站：www.jiyufund.com.cn

(20) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2

公司地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

公司网站：www.hcfunds.com

(21) 北京度小满基金销售有限公司



注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼

法定代表人：葛新

客服电话：95055

公司网站：www.duxiaomanfund.com

(22) 华宝证券股份有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区浦电路370号2、3、4层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：刘加海

联系方式：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

(23) 中国人寿保险股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街16号

法定代表人：王滨

客服电话：95519

公司网站：www.chinalife.com.cn

(24) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：陈四清

客户电话：95588

公司网站：www.icbc.com.cn

(25) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

客服电话：95555

公司网站：www.cmbchina.com

(26) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路168号

办公地址：上海市银城中路168号

法定代表人：金煜

客服电话：95594

公司网站：www.bosc.cn

(27) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：谢永林

客服电话：95511

公司网站：www.bank.pingan.com

(28) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市黄浦区中山东一路12号

法定代表人：郑杨

客服电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

(29) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：刘连舸

客服电话：95566

公司网站：www.boc.cn

(30) 宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路345号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路345号

法定代表人：陆华裕

客服电话：95574

公司网站：www.nbcb.com.cn

(31) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：田国立

客服电话：95533

公司网站：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(32) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路154号

法定代表人：吕家进

客服电话：95561

公司网站：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(33) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：高迎欣

客服电话：95568

公司网站：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(34) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：任德奇

客服电话：95559

公司网站：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(35) 青岛银行股份有限公司

注册地址：山东省青岛市崂山区秦岭路6号3号楼

办公地址：山东省青岛市崂山区秦岭路6号3号楼

法定代表人：郭少泉

客服电话：400-669-6588（全国）、96588（青岛）

公司网站：[www.qdccb.com](http://www.qdccb.com)

(36) 南京银行股份有限公司

注册地址：南京市玄武区中山路288号

办公地址：南京市玄武区中山路288号

法定代表人：胡升荣

联系方式：95302

网址：[www.njcb.com.cn](http://www.njcb.com.cn)

(37) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特8号

办公地址：湖北省武汉市新华路特8号

法定代表人：李新华

客服电话：95579

公司网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(38) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：张伟

客服电话：95597

公司网站：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(39) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李峰

客服电话：95538

公司网站：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

(40) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

法定代表人：林传辉

联系电话：86-20-87550265, 86-20-87550565

客服电话：95575

公司网站：www.gf.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金。

## **(二) 登记机构**

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：于文强

电话：010-50938600

传真：010-58598907

联系人：赵亦清

## **(三) 出具法律意见书的律师事务所**

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

负责人：韩炯

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

## **(四) 审计基金财产的会计师事务所**

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼

法人代表：李丹

经办注册会计师：陈熹、叶尔甸

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：乐美昊

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关规定募集，募集申请经中国证监会2015年11月19日证监许可【2015】2666号文准予注册。

### （一）基金类型

混合型证券投资基金。

### （二）基金运作方式

契约型开放式。

### （三）基金存续期限

不定期。

### （四）基金募集情况

募集期为2016年5月18日至2016年7月4日。经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验资，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，募集期共募集771,371,084.49份基金份额（含利息转份额），有效认购户数为6,887户。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效

根据有关规定，本基金满足《基金合同》生效条件，《基金合同》于2016年7月11日正式生效。自《基金合同》生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。



## 八、基金份额的申购、赎回与转换

### （一）申购与赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构。

投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### （二）申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，若该工作日为非港股通交易日，则本基金不开放，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人可对开放日和开放日的具体业务办理时间进行调整，但此项调整应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月的时间内开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月的时间内开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

本基金于2016年9月28日开放申购、赎回、定期定额投资业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额

申购、赎回的价格。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即基金份额持有人在赎回基金份额，基金管理人对该基金份额持有人的基金份额进行赎回处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回申请的提出

投资人必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金时，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

#### 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），正常情况下，基金管理人或其委托的登记机构在T+1日内为投资人对该交易的有效性进行确认。

T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，否则，如因申请未得到基金管理人或登记机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以基金登记机构或基金

管理人的确认结果为准。

### 3、申购和赎回申请的款项支付

基金申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者银行账户。基金份额持有人赎回申请确认后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人银行账户。

## （五）申购和赎回的数额限定

### 1、申购金额的限制

通过本公司直销中心及网上交易系统申购本基金基金份额的单笔最低金额为10元人民币（含申购费），通过代销机构申购本基金基金份额的最低申购限额及交易级差以各代销机构的具体规定为准。投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受基金份额最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次对本基金基金份额的赎回申请不得低于0.01份。本基金基金份额持有人每个交易账户的最低份额余额为0.01份。

3、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资人申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人届时的相关公告。

4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## （六）基金的申购费和赎回费

### 1、申购费率

本基金对通过基金管理人直销中心申购本基金的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运

营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品、个人税收递延型商业养老保险等产品、养老目标基金以及职业年金计划等。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

(1) 通过基金管理人直销中心申购本基金的养老金客户的申购费率如下：

申购金额 (M)	费率
M < 100 万元	0.30%
100 万 ≤ M < 500 万元	0.18%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

(2) 其他投资者可选择在申购或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的申购费用称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的申购费用称为后端申购费用。申购费用的收取方式以销售机构的公告为准。

① 投资者选择交纳前端申购费用时，前端申购费率按申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。前端申购费率如下：

申购金额 (M)	前端申购费率
M < 100 万元	1.50%
100 万 ≤ M < 500 万元	1.00%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

② 投资者选择交纳后端申购费用时，后端申购费率按基金份额持有时间的增加而递减，后端申购费率具体如下：

份额持续持有时间 (L)	后端申购费率
L < 1年	1.80%
1年 ≤ L < 2年	1.20%
2年 ≤ L < 3年	0.60%
L ≥ 3年	0

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的

市场推广、销售、登记等各项费用。

因红利自动再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。

## 2、赎回费率

本基金在赎回时收取基金赎回费用，赎回费率随赎回基金份额持有时间的增加而递减。根据份额持有时间分档收取，具体见下表：

份额持续持有时间 (L)	适用赎回费率
L<7 日	1.5%
7 日 $\leq$ L<30 日	0.75%
30 日 $\leq$ L<365 日	0.5%
365 日 $\leq$ L<730 日	0.3%
L $\geq$ 730 日	0

赎回费用由基金赎回人承担。对份额持续持有时间小于30日的，赎回费用全部归基金财产，对份额持续持有时间大于等于30日小于3个月的，赎回费用总额的75%归基金财产，对份额持续持有时间大于等于3个月但小于6个月的，赎回费用总额的50%归基金财产，对份额持续持有时间大于等于6个月的，赎回费用总额的25%归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒介公告。

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## (七) 申购和赎回的数额和价格

### 1、基金份额的申购份额计算：

(1) 如果投资者选择交纳前端申购费用，则基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

例一：某投资人（非养老金客户）投资4万元申购基金份额，申购费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.040元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额 =  $40,000 / (1 + 1.5\%) = 39,408.87$ 元

申购费用 =  $40,000 - 39,408.87 = 591.13$ 元

申购份额 =  $39,408.87 / 1.040 = 37,893.14$ 份

即：该投资人（非养老金客户）投资4万元申购基金份额，假定申购当日基金份额净值为1.040元，可得到37,893.14份基金份额。

(2) 如果投资者选择交纳后端申购费用，则申购份额及后端申购费用的计算方法如下：

申购基金时，

申购份额 = 申购金额 / 申购当日基金份额净值

赎回基金份额时，投资者应交纳后端申购费用，

后端申购费用 = 赎回基金份额 × 基金份额申购当日份额净值 × 对应的后端申购费率

## 2、赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总金额 = 赎回份额 × T日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用-后端申购费用（如有）

例二：某投资人赎回1万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.016元，假设持有时间对应的赎回费率为0.5%，其在认购/申购时已交纳认购费用/前端申购费用，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.016=10160.00元

赎回费用 = 10,000×1.016×0.5% = 50.80 元

净赎回金额 = 10,000×1.016- 50.80=10,109.20元

即：投资人赎回本基金1万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.016元，假设持有时间对应的赎回费率为0.5%，其在认购/申购时已交纳认购费用/前端申购费用，则其可得到的净赎回金额为10,109.20元。

例三：某投资人赎回1万份基金份额，赎回当日基金份额净值是1.016元，假设持有时间为1.5年，所对应的赎回费率为0.3%，其在申购时选择交纳后端申购费用，所对应的后端申购费率为1.20%，申购当日基金份额净值是1.010元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.016=10160.00元

后端申购费用=10,000×1.010×1.20%=121.20元

赎回费用 =10,000×1.016×0.3% = 30.48元

净赎回金额 =10,000×1.016-30.48- 121.20=10,008.32元

即：投资人赎回本基金1万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.016元，假设持有时间为1.5年，所对应的赎回费率为0.3%，其在申购时选择交纳后端申购费用，所对应的后端申购费率为1.20%，申购当日基金份额净值是1.010元，则其可得到的净赎回金额为10,008.32元。

### 3、本基金基金份额净值的计算：

本基金基金份额净值的计算，均保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。本基金开放申购赎回后，T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### 4、申购份额的余额的处理方式：

申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，

申购份额、申购金额均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

#### 5、赎回金额的余额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额、赎回费用、后端申购费用计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

### （八）申购和赎回的登记

投资者T日申购基金成功后，基金登记机构在T+1日为投资者登记权益并办理登记手续，投资者自T+2日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者T日赎回基金成功后，基金登记机构在T+1日为投资者办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并应在调整实施日前依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒介公告。

### （九）拒绝或暂停申购的情形

出现如下情形时，基金管理人可以暂停或拒绝投资人的申购申请：

- 1、不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请；当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并采取暂停接受基金申购申请的措施；
- 3、证券、期货交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人的利益；
- 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构因技术故障或异常



情况导致基金销售系统或基金登记系统或基金会计系统无法正常运行；

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时；

8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资人单日申购金额上限，基金管理人有权对该等申购申请进行部分确认或拒绝接受该等申购申请；

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。

发生上述1、2、3、5、6、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### **(十) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形**

出现如下情形时，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

1、不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项；当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

4、连续2个或2个以上开放日巨额赎回；

5、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金登记系统或基金会计系统无法正常运行；

6、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款

项时，基金管理人应在当日向中国证监会备案。已确认赎回的申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。

同时，在出现上述第4款的情形时，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在指定媒介上公告。

### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

（1）全额赎回：当有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分顺延赎回：当支付投资人的赎回申请有困难或认为支付投资人的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）在发生巨额赎回，且单个基金份额持有人赎回申请超过上一日基金总份额30%的情形下，对单个基金份额持有人超过上一日基金总份额30%以上的赎回

申请，基金管理人应当延期办理赎回。对该单个基金份额持有人30%以内（含30%）的赎回申请按普通基金份额持有人（即其他赎回申请未超过上一工作日基金总份额30%以上的基金份额持有人）赎回程序（包括巨额赎回）办理，对该单个基金份额持有人超过30%的赎回申请进行延期办理。对于未能赎回部分，该基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回，如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

（4）暂停赎回：本基金连续2个开放日以上发生巨额赎回，如有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在指定媒介上刊登公告。

## （十二）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、基金管理人应于恢复开放申购或赎回日前，在指定媒介上刊登基金恢复开放申购或赎回公告，并公布最近1个工作日的基金份额净值。

## （十三）基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## （十四）基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构

办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的,将提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

#### **(十五) 基金的非交易过户**

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理,并按基金登记机构规定的标准收费。

#### **(十六) 基金份额的转托管**

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### **(十七) 定期定额投资计划**

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### **(十八) 基金份额的冻结与解冻**

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻以及登记机构认可的其他情况下的冻结与解冻。

## 九、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金通过对宏观经济形势、行业发展趋势和企业基本面的深入研究，把握港股通等后续资本市场开放形势下 A 股与港股市场互联互通的投资机会，寻求基金资产的长期稳健增值。

### (二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票及存托凭证（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金将基金资产的0%-95%投资于股票资产（含存托凭证）（其中投资于国内依法发行上市的股票、存托凭证的比例占基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-95%），权证投资比例不超过基金资产净值的3%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### (三) 投资策略

本基金是一只灵活配置的混合型基金，采取主动管理的投资模式。在投资策略上，先根据宏观分析和市场判断确定大类资产的配置，即确定权益类资产和固定收益类资产的投资比例；然后通过比较各行业所处的发展阶段、竞争趋势、景气程度和发展空间等在不同行业间进行动态配置；最后通过比较 A 股与港股市场同类公司的质地及估值水平等要素，进行个券选择，构建合理的投资组合。

#### 1、资产配置

本基金通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。

本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产配置权重，实现资产合理配置。

## 2、股票组合的构建

随着港股通的开启和不断推进，两岸资本市场之间加速互相渗透。本基金将充分挖掘港股通互联互通机制下，A 股市场和港股市场的投资机会。在基金合同约定的投资比例范围内制定国内A股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例及投资策略。具体：

### （1）A股投资策略

本基金将重点关注：

- 1) 符合国家改革和经济转型方向的公司，这类公司多受益于政策红利，具有良好成长空间。
- 2) 拥有高进入壁垒的公司，主要指具有创新技术优势、品牌优势、产业链优势、定价能力的上市公司。
- 3) 公司治理结构完善、经营管理稳定的公司。
- 4) 创造现金流的能力较强以及分红派息政策稳定透明的公司。
- 5) 估值水平具有吸引力，或者在港股通背景下估值水平能够有较大提升的公司。

### （2）港股投资策略

本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注：

- 1) A股稀缺性行业和个股，如博彩；
- 2) 具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业应具有良好成长性或为市场龙头；
- 3) 符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股；
- 4) 与A股同类公司相比具有估值优势的公司。

### （3）个股投资策略

个股投资策略遵循“自下而上”的原则，结合定性与定量分析选择个股。

在定性分析方面，通过投研团队对公司的资料分析和实地调研，对公司的管理、商业模式、竞争优势等进行深入了解和分析。

在定量分析方面，针对行业和公司特点，利用相关指标具体考察财务情况、运营情况与成长性。例如营业利润率、净利率、每股收益（EPS）增长、主营业务收入增长等，并综合利用市盈率法（P/E），市净率法（P/B）、折现现金流法（DCF）对公司进行合理估值。

### （4）存托凭证的投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照上述内地上市交易的股票投资策略执行。

### 3、债券等其他固定收益类投资策略

本基金的固定收益类投资品种主要有国债、企业债等中国证监会认可的，具有良好流动性的金融工具。固定收益投资主要用于提高非股票资产的收益率，管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。

在债券投资方面，管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。

### 4、中小企业私募债券投资策略

由于中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。在进行投资时，将采取分散投资、锁定收益策略。在遴选债券时，将只投资有担保或者国有控股企业发行的中小企业私募债，以降低信用风险。

### 5、资产支持证券投资策略

本基金资产支持证券的投资配置策略主要从信用风险、流动性、收益率几方面来考虑，采用自下而上的项目精选策略，以资产支持证券的优先级或次优先级为投资标的，精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目。根据不同资产支持证券的基础资产采取适度分散的地区配置策略和行业配置策略，在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。资产支持证券的信用

风险分析采取内外结合的方法，以基金管理人的内部信用风险评估为主，并结合外部信用评级机构的分析报告，最终得出对每个资产支持证券项目的总体风险判断。另外，鉴于资产支持证券的流动性较差，本基金更倾向于久期较短的品种，即使持有到期压力也不会太大。

#### 6、股指期货投资策略

本基金投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

#### 7、国债期货投资策略

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

#### 8、权证投资策略

本基金在权证投资中以对应的标的证券的基本面为基础，结合权证定价模型、隐含波动率、交易制度设计等多种因素对权证进行合理估值，谨慎投资，在风险可控的前提下实现较稳定的当期收益。本基金权证投资的原则为有利于基金资产增值、加强基金风险控制。

#### 9、基金管理人运用基金财产的投资决策依据和投资决策程序

为了保证整个投资组合计划的顺利贯彻与实施，本基金遵循以下投资决策依据以及具体的决策程序：

##### (1) 投资决策依据

投资决策依据包括：国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定；宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势；证券市场走势。

##### (2) 投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易，及严格控制。

##### (3) 投资决策机制

本基金采用基金业务投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

基金业务投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例等重大投资



决策。

基金经理在公司研究部、固定收益部、基金投资部、量化投资部的协助与支持下,在基金投资决策委员会确定的投资范围和资产配置范围内制定并实施具体的投资决策,构建和调整投资组合,并向交易室下达投资指令。

交易室负责交易执行和一线监控。通过严格的交易制度和实时的一线监控功能,保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

#### (4) 投资管理流程

基金投资决策委员会是本基金的最高决策机构,基金投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、研究员、交易员在投资管理过程中既密切合作,又责任明确,在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的投资管理程序如下:

1) 基金投资决策委员会定期召开投资决策会议,对资产配置比例提出指导性意见,并讨论股票、债券的投资重点等;

2) 基金经理根据投资决策委员会决议,依据宏观分析师、策略研究员的宏观经济分析和策略建议、行业研究员的行业分析和个股研究、债券研究员的债券市场研究和券种选择、量化研究员的定量投资策略研究,结合本基金产品定位及风险控制的要求,在权限范围内制定具体的投资组合方案;

3) 基金经理根据基金投资组合方案,向交易室下达交易指令;

4) 交易指令通过风控系统的自动合规核查后,由交易室执行,交易室对交易情况及时反馈;

5) 基金经理对每日交易执行情况进行回顾,并审视基金投资组合的变动情况;

6) 合规与风险管理部定期完成有关投资风险监控报告,量化投资部定期完成基金业绩评估报告。

基金投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要,对上述投资管理程序作出调整。

#### (四) 投资限制

##### 1、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1) 本基金投资组合中股票资产（含存托凭证）投资比例为基金资产的 0%—95%；

(2) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(3) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(4) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；

本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(5) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%；

(6) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(7) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(8) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(9) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(10) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(11) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(12) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(13) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。

基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

(14) 本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

(16) 本基金每个交易日日终，持有国债期货或股指期货合约的，持有的买入国债期货和股指期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(17) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

本基金管理人将按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

(18) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(19) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

(20) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的10%；

(21) 本基金持有一家企业发行的单期中期票据，其市值不得超过本基金资产净值的10%；

(22) 进入全国银行间同业市场的基金管理公司进行债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；进入全国银行间同业市场的基金管理公司进行债

券回购的资金余额不得超过基金净资产的 40%；

(23) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(24) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(25) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(26) 本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制，基金管理人及时根据《信息披露办法》规定在指定媒介公告，且不需要经基金份额持有人大会审议。

除 (3)、(13)、(24)、(25) 条外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

### 3、关联交易原则

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

#### (六) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $\text{沪深300指数} \times 40\% + \text{恒生指数} \times 40\% + \text{中国债券总指数收益率} \times 20\%$

其中，沪深300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A 股市场总体发展趋势。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价格趋势最有影响的一种股价指数。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于2001年12月31日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩

比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，本基金可以变更业绩比较基准，但应与基金托管人协商一致，在履行适当程序后报中国证监会备案，并在中国证监会指定的媒介上及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

### （七）风险收益特征

本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

本基金除了投资A股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### （八）基金管理人代表基金行使股东权利和债权人的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

### （九）基金投资组合报告

以下投资组合报告数据截至2021年12月31日。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4,956,713,399.91	85.34
	其中：股票	4,956,713,399.91	85.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,247,300.00	0.09
	其中：债券	5,247,300.00	0.09
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售	-	-

	金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	844,890,612.56	14.55
8	其他资产	1,282,387.75	0.02
9	合计	5,808,133,700.22	100.00

注：①本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为784,375,042.22元人民币，占期末基金资产净值比例13.60%。

②本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	28,868,170.00	0.50
C	制造业	3,344,802,414.18	58.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	321,212,050.00	5.57
E	建筑业	280,983,872.30	4.87
F	批发和零售业	399,284.56	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	89,146,314.00	1.55
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	106,041,449.55	1.84
J	金融业	69,749.68	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	719,571.40	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	52,941.71	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	37,932.31	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,172,338,357.69	72.35

### (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-

25 可选消费	527,404,426.90	9.14
30 主要消费	32,207,103.60	0.56
35 医药卫生	3,348.07	0.00
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 通信服务	83,200,441.79	1.44
55 公用事业	-	-
60 房地产	141,559,721.86	2.45
合计	784,375,042.22	13.60

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	9,140,993	449,736,855.60	7.80
2	002791	坚朗五金	1,611,798	292,686,398.82	5.07
3	601311	骆驼股份	15,123,262	231,839,606.46	4.02
4	300750	宁德时代	354,730	208,581,240.00	3.62
5	601012	隆基股份	2,289,916	197,390,759.20	3.42
6	603606	东方电缆	3,666,719	187,589,344.04	3.25
7	600893	航发动力	2,882,869	182,946,866.74	3.17
8	002179	中航光电	1,707,800	171,736,368.00	2.98
9	600905	三峡能源	22,354,800	167,884,548.00	2.91
10	601117	中国化学	13,213,512	158,562,144.00	2.75

注：对于同时在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,247,300.00	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-



10	合计	5,247,300.00	0.09
----	----	--------------	------

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127052	杭锅转债	52,473	5,247,300.00	0.09

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行股指期货投资。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行国债期货投资。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

#### 11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金持有的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,207,627.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	74,760.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,282,387.75

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十、基金的业绩

基金管理人依据恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

以下基金业绩数据截至2021年12月31日。

1、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2016年7月11日至 2016年12月31日	3.00%	0.37%	4.03%	0.59%	-1.03%	-0.22%
2017年1月1日至 2017年12月31日	66.60%	0.80%	21.53%	0.47%	45.07%	0.33%
2018年1月1日至 2018年12月31日	-21.15%	1.48%	-14.62%	0.97%	-6.53%	0.51%
2019年1月1日至 2019年12月31日	51.44%	1.23%	17.90%	0.80%	33.54%	0.43%
2020年1月1日至 2020年12月31日	38.65%	1.52%	9.33%	1.08%	29.32%	0.44%
2021年1月1日至 2021年12月31日	1.44%	1.48%	-7.00%	0.87%	8.44%	0.61%
2016年7月11日至 2021年12月31日	188.20%	1.28%	29.39%	0.84%	158.81%	0.44%

2、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方红沪港深混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



# 十一、基金的财产

## （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

## （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

## （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

## （四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有财产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### （二）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证、股指期货合约、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产和负债。

#### 1、估值依据及原则

估值应符合基金合同、《证券投资基金会计核算业务指引》、证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、中国证监会[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。基金管理人、基金托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

#### 2、估值的基本原则：

（1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值。估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，应采用最近交易市价确定公允价值。如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

（2）对不存在活跃市场的投资品种，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。运用估值技术得出的结果，应反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。采用估值技术确定公允价值时，应尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场

参数，并应通过定期校验，确保估值技术的有效性。

(3) 有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理人应根据具体情况与基金托管人进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

### (三) 估值方法

以下估值方法中所指的固定收益品种，是指在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、中小企业私募债、资产支持证券等品种。

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 交易所上市实行净价交易的固定收益品种按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定；

(3) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去收盘价或估值全价中所含的应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。

(5) 交易所上市不存在活跃市场的权益类证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的同一股票的估值方法估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值；对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

4、中小企业私募债采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、投资证券衍生品的估值方法

(1) 从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生



了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

(4) 股指期货合约以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的结算价估值。

(5) 国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

#### 7、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### 8、汇率

本基金外币资产价值计算中，涉及港币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。

若无法取得上述汇率价格信息时，以基金托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。

#### 9、基金投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。

10、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

11、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并需履行相关信息披露义务。

12、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，

按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据《基金法》，基金管理人计算基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人计算的结果对外予以公布。

#### **（四）估值程序**

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### **（五）估值差错的处理**

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值差错时，视为基金份额净值差错。

关于估值差错处理，基金合同的当事人按照以下约定处理：

##### **1、估值差错类型**

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，责任方应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数

据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

## 2、估值差错处理原则

(1) 估值差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值差错发生的费用由差错责任方承担；由于估值差错责任方未及时更正已产生的估值差错，给当事人造成损失的由估值差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 估值差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值差错责任方仍应对估值差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 估值差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 估值差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人原因造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人原因造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错责任方追偿。

(6) 如果出现估值差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理估值差错。

## 3、估值差错处理程序

估值差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值差错发生的原因确定估值差错的责任方；

(2) 根据估值差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据估值差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值差错处理的方法，需要修改基金登记机构的交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值差错的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值差错处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

(3) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金额，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任，如双方无法就责任分担达成一致的，基金管理人和基金托管人根据仲裁裁决分别承担责任。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对或对基金管理人采用的估值方法，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额

持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等)，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商处理。

#### **(六) 暂停估值的情形**

1、与本基金投资有关的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

#### **(七) 基金净值的确认**

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### **(八) 特殊情形的处理**

1、基金管理人、基金托管人按估值方法的第10项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值差错处理；

2、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值差错，基金管理人

和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 十三、基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### （二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### （三）基金收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至基金收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在指定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

### （六）基金收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者

的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》的有关规定执行。



## 十四、基金的费用与税收

### (一) 与基金运作有关的费用

#### 1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (4) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金的证券、期货交易费用；
- (7) 基金的银行汇划费用；
- (8) 证券、期货账户开户费和账户维护费；
- (9) 投资港股通标的股票的相关费用；
- (10) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### (1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### (2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

$$H=E\times 0.25\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述基金费用的种类中第（3）—（10）项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1、申购费率

本基金对通过基金管理人直销中心申购本基金的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品、个人税收递延型商业养老保险等产品、养老目标基金以及职业年金计划等。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

（1）通过基金管理人直销中心申购本基金的养老金客户的申购费率如下：

申购金额（M）	费率
M<100 万	0.30%
100 万≤M<500 万	0.18%
M≥500 万元	每笔 1000 元

(2) 其他投资者可选择在申购或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的申购费用称为前端申购费用,投资者选择在赎回时交纳的申购费用称为后端申购费用。申购费用的收取方式以销售机构的公告为准。

①投资者选择交纳前端申购费用时,前端申购费率按申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。前端申购费率如下:

申购金额 (M)	前端申购费率
M < 100 万	1.50%
100 万 ≤ M < 500 万	1.00%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

②投资者选择交纳后端申购费用时,后端申购费率按基金份额持有时间的增加而递减,后端申购费率具体如下:

份额持续持有时间 (L)	后端申购费率
L < 1年	1.80%
1年 ≤ L < 2年	1.20%
2年 ≤ L < 3年	0.60%
L ≥ 3年	0

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

因红利自动再投资而产生的基金份额,不收取相应的申购费用。

## 2、赎回费率

本基金在赎回时收取基金赎回费用,赎回费率随赎回基金份额持有时间的增加而递减。根据份额持有时间分档收取,具体如下:

份额持续持有时间 (L)	适用赎回费率
L < 7 日	1.5%
7 日 ≤ L < 30 日	0.75%
30 日 ≤ L < 365 日	0.5%
365 日 ≤ L < 730 日	0.3%
L ≥ 730 日	0

赎回费用由基金赎回人承担。对份额持续持有时间小于30日的，赎回费用全部归基金财产，对份额持续持有时间大于等于30日但小于3个月的，赎回费用总额的75%归基金财产，对份额持续持有时间大于等于3个月但小于6个月的，赎回费用总额的50%归基金财产，对份额持续持有时间大于等于6个月的，赎回费用总额的25%归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒介公告。

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

### **（三）不列入基金费用的项目**

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### **（四）费用调整**

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。

调高基金管理费率、基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议，基金

合同另有约定的除外；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### **（五）基金税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告。

## 十六、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### (二) 信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人及其日常机构等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点,按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)及指定互联网网站(以下简称“指定网站”)等媒介披露,并保证投资人能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### (三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;
- 2、对证券投资业绩进行预测;
- 3、违规承诺收益或者承担损失;
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

(四) 本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

### (五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

(1) 《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及投资人重大利益的事项的法律文件。

(2) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响投资人决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

(3) 基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

(4) 基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

基金募集申请经中国证监会准予注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在各自网站上。

#### 2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

#### 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

#### 4、基金开始申购、赎回公告

基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定于申购开始日、赎回开始日



前在指定媒介上公告。

#### 5、基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 6、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（合称“基金定期报告”）

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性报告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

报告期内出现单一投资人持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资人权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资人的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### 8、临时报告与公告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- (1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- (2) 《基金合同》终止、基金清算；
- (3) 转换基金运作方式、基金合并；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (7) 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- (8) 基金募集期延长或提前结束募集；
- (9) 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- (10) 基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十；
- (11) 基金管理人、基金托管人基金专门托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十；
- (12) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- (13) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (14) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证

券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

(15) 基金收益分配事项；

(16) 管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值0.5%；

(18) 本基金开始办理申购、赎回；

(19) 本基金发生巨额赎回并延期办理；

(20) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

(21) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

(22) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；

(23) 调整基金份额类别设置；

(24) 基金管理人采用摆动定价机制；

(25) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

## 9、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

## 10、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

## 11、投资中小企业私募债的信息披露

基金管理人应当在本基金投资中小企业私募债券后2个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。基金管理人应当在基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

## 12、投资股指期货的信息披露

基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金年度报告等定期报告

和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### 13、投资国债期货的信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对本基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

#### 14、投资资产支持证券的信息披露

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

#### 15、投资香港联合交易所上市的股票的信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本基金参与港股通交易的相关情况。

#### 16、中国证监会规定的其他信息。

### （六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金

信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

#### **（七）信息披露文件的存放与查阅**

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

## 十七、风险揭示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

投资人应当认真阅读本基金《基金合同》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》等基金信息披露文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资人的风险承受能力相适应，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

基金管理人提醒投资人在作出投资决策后，须了解并自行承担以下风险：

### （一）东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金的主要风险

本基金面临包括但不限于以下风险：

#### 1、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

##### （2）经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对本基金的收益产生影响。

##### （3）利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的证券价格和证券利息的损益。利率波动

会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使基金收益水平随之发生变化，从而产生风险。

#### （4）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

#### （5）衍生品风险

金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

#### （6）购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

#### （7）权证投资风险

权证定价复杂，交易制度更加灵活，杠杆效应较强，与传统证券相比价格波动幅度更大。另外，权证价格受市场投机、标的证券价格波动、存续期限、无风险利率等因素的影响，价格波动不易把握。因此投资权证的收益不确定性更大，从而影响基金投资收益。

### 2、管理风险

在基金运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如基金管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响基金的收益水平，从而产生风险。

### 3、本基金的主要流动性风险及管理办法

#### （1）基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”章节。

#### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金拟投资的市场包括A股市场，银行间和交易所的债券市场等，从投资品种来看，本基金的大部分投资标的都是在证券交易所上市的有价证券，或是在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，这些标的往往

存在公开交易市场、具有活跃的交易特性、估值政策清晰，因此，从投资标的的挑选上，流动性有一定的保障。

### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

1) 全额赎回：当有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2) 部分顺延赎回：当支付投资人的赎回申请有困难或认为支付投资人的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3) 在发生巨额赎回，且单个基金份额持有人赎回申请超过上一日基金总份额30%的情形下，对单个基金份额持有人超过上一日基金总份额30%以上的赎回申请，基金管理人应当延期办理赎回。对该单个基金份额持有人30%以内（含30%）的赎回申请按普通基金份额持有人（即其他赎回申请未超过上一工作日基金总份额30%以上的基金份额持有人）赎回程序（包括巨额赎回）办理，对该单个基金份额持有人超过30%的赎回申请进行延期办理。对于未能赎回部分，该基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回，如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

4) 暂停赎回：本基金连续2个开放日以上发生巨额赎回，如有必要，可暂停



接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介公告。

(4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响  
基金管理人经与基金托管人协商一致，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。本基金的流动性风险管理工具包括但不限于：

- 1) 延期办理巨额赎回申请；
- 2) 暂停接受赎回申请；
- 3) 延缓支付赎回款项；
- 4) 收取短期赎回费；
- 5) 暂停基金估值；
- 6) 摆动定价；
- 7) 中国证监会认定的其他措施。

具体处理程序详见基金合同相关约定，以上流动性管理工具将使投资者无法及时全部或部分赎回基金份额，无法及时全部或部分获得赎回款项，在赎回时需支付短期赎回费等。

#### 4、信用风险

基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，造成基金资产损失的风险。

#### 5、技术风险

在基金的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致基金投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券、期货交易所、证券、期货登记结算机构等。

#### 6、操作风险

基金管理人、基金托管人、证券、期货交易所、证券、期货登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

#### 7、本基金将有部分资产投资于中小企业私募债券，将面临如下风险：

(1) 由于中小企业私募债券采取非公开发行的方式发行，即使在市场流动性比较好的情况下，个别债券的流动性可能较差，从而使得基金在进行个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对价格产生比较大的影响，增加个券的建仓成本或变现成本。

(2) 中小企业私募债券信用等级较一般债券较低，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险，此外，当发行人信用评级降低时，基金所投资的债券可能面临价格下跌风险。

#### 8、本基金参与债券回购的风险

债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

#### 9、参与股指期货的风险

(1) 本基金使用股指期货的目的是套期保值，风险较纯粹投机要小，总体可控。但由于股票多头和股指期货空头头寸在流动性、风险收益特征及交易规则上的不同可能造成两个头寸对相同市场风险的反应存在差异，尤其是对大幅度的市场波动反应不一定完全同步，从而加大投资组合市场价值的短期风险。

(2) 股指期货采用保证金交易的特征使投资组合的空头头寸在沪深300股指期货上涨时需要追加保证金，如果无法及时补足保证金将面临空头头寸被平仓的风险。由于在封闭期内，本基金在非保证金账户还保留与保证金账户相同资金量的现金，且在股指上升过程中股票多头的流动性一般很强，可及时卖出获取现金，故空头头寸被强制平仓的风险非常之小。

(3) 使用股指期货对冲市场风险的过程中，委托财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将期货合约展期时，

合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性，面临跨期基差风险。但总体而言，基差风险绝对值较小，属于可控、可知、可承担的风险。

#### 10、参与国债期货的风险

(1) 杠杆性风险。国债期货交易采用保证金交易方式，潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。

(2) 到期日风险。国债期货合约到期时，如本基金仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将本基金持有的合约进行现金交割，本基金存在无法继续持有到期合约的可能，具有到期日风险。国债期货合约采取实物交割方式，如本基金未能在规定期限内如数交付可交割国债或者未能在规定期限内如数缴纳交割贷款，将构成交割违约，交易所将收取相应的惩罚性违约金。

(3) 强制平仓风险。如本基金参与交割不符合交易所或者期货公司相关业务规定，期货公司有权不接受本基金的交割申请或对本基金的未平仓合约强行平仓，由此产生的费用和结果将由基金承担。

(4) 使用国债期货对冲市场风险的过程中，委托财产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将期货合约展期时，合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性，面临跨期基差风险。

#### 11、投资科创板股票的风险

本基金还可投资国内上市的科创板股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于如下特殊风险：

(1) 科创板股票股价波动较大的风险。

科创板对个股每日涨跌幅限制为20%，且新股上市后的前5个交易日不设置涨跌幅限制，股价可能表现出比A股其他板块更为剧烈的波动。

(2) 科创板股票退市的风险。

科创板执行比A股其他板块更为严格的退市标准，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，可能会对基金净值产生不利影响。

(3) 科创板股票流动性较差的风险。

由于科创板投资门槛高于A股其他板块，整体板块活跃度可能弱于A股其他板块。科创板机构投资者占比较大，板块股票存在一致性预期的可能性高于A股其

他板块，在特殊时期存在基金交易成交等待时间较长或无法成交的风险。

(4) 科创板上市公司在商业模式、盈利模式等方面可能存在一定相似性，因此科创板股票股价存在同向波动的可能，在市场表现不佳时可能对基金净值产生不利影响。

## 12、本基金特有投资策略带来的风险

本基金属于混合型基金，将根据资本市场情况灵活选择权益类、固定收益类资产投资比例及策略，因此本基金将受到来自权益市场及固定收益市场两方面风险：一方面如果固定收益市场系统性风险爆发或对各类固定收益金融工具的选择不准确都将对本基金的净值表现造成不利影响；另一方面，对股票市场的筛选与判断是否科学、准确，基本面研究以及定量分析的准确性，也将影响到本基金所选券种是否符合预期投资目标，尤其需要注意的是本基金可以投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于：

### (1) 海外市场风险。

本基金在参与港股市场投资时将受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险。

### (2) 股价波动较大的风险。

港股市场实行T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比A 股更为剧烈的股价波动，本基金的波动风险可能相对较大。

### (3) 汇率风险

本基金在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率，港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率，本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率

的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

#### （4）港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有每日额度上限的限制；本基金可能因为港股通市场每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。

#### （5）港股通可投资标的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入，本基金可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

#### （6）港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯、港股不能及时卖出的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易），导致基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应，可能带来一定的流动性风险，造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

#### （7）交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行T+2日（T日买卖股票，资金和股票在T+2日才进行交收）的交收安排，本基金在T日（港股通交易日）卖出股票，T+2日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在T+3日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险。

#### （8）港股通标的权益分派、转换等的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本基金因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所

上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

#### （9）香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地A 股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与A 股市场存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记(例如，ST 及\*ST 等标记)以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板，联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得联交所上市公司的退市情形较A 股市场相对复杂。

因该等制度性差异，本基金可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

#### （10）港股通规则变动带来的风险

本基金是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资，受港股通规则的限制和影响；本基金存在因港股通规则变动而带来基金投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

#### （11）其他可能的风险

除上述显著风险外，本基金参与港股通投资，还可能面临的其他风险，包括但不限于：

①除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费外，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，本基金存在因费用估算不准而导致账户透支的风险；

②在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏，本基金投资此类股票可能因缺乏交易对手而面临个股流动性风险；

③在本基金参与港股通交易中若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

④存在港股通香港结算机构因极端情况下无法交付证券和资金的结算风险；另外港股通境内结算实施分级结算原则，本基金可能面临以下风险：（一）因结

算参与人未完成与中国结算的集中交收,导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置;(二)结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金;(三)结算参与人向中国结算发送的有关本基金的证券划付指令有误的导致本基金权益受损;(四)其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况。

⑤本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股。

### 13、参与存托凭证的风险

存托凭证由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行,代表境外基础证券权益。本基金可投资存托凭证,基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响,与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外交易机制相关的风险可能直接或间接成为本基金风险。

#### (1) 与存托凭证相关的风险

1) 存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当,但不能等同于直接持有境外基础证券,存托凭证与基础证券所代表的权利在范围和行使方式等方面的存在差异。同时,存托凭证具有证券交易普遍存在的宏观经济风险、政策风险、市场风险、不可抗力风险。

2) 存托凭证存续期间,存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化,包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、发行主体和存托人可能对存托协议作出修改、更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。

3) 存托凭证存续期间,对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形,本基金可能存在失去应有权利的风险。

4) 若存托凭证退市,本基金可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券、本基金持有的存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让、存托人无法继续按照存托协议的约定提供相应服务等风险。

#### (2) 与存托凭证的境外基础证券发行人相关的风险

1) 境外基础证券发行人在境外注册设立,适用境外注册地公司法等法律法规的规定以及境外上市地相关规则。本基金可能需要承担跨境行使权利或者维护权利的成本和负担。同时,本基金参与存托凭证享有的权益可能受境外法律变化

影响。

2) 境外基础证券发行人可能仅在境内市场发行并上市较小规模的存托凭证, 公司大部分或者绝大部分的表决权由境外股东等持有; 另外若发行人设置投票权差异安排的, 投资者投票权利也可能存在较大差异。本基金可能无法实际参与公司重大事务的决策。

3) 境外基础证券发行人如果采用协议控制架构, 可能由于法律、政策变化带来合规、经营等风险, 可能面临对境内实体运营企业重大依赖、协议控制架构下相关主体违约等风险。

4) 境外基础证券发行人决定分红后, 将有换汇、清算等程序, 可能导致本基金取得分红派息时间较境外有所延迟。同时, 延迟期间的汇率波动, 也可能导致本基金实际取得分红派息与境外投资者存在一定差异。分红派息还可能因外汇管制、注册地法规政策等发生延迟或税费。

5) 本基金无法直接作为境外基础证券发行人境外注册地或者境外上市地的投资者, 依据当地法律制度提起证券诉讼。

### (3) 与境内外交易机制相关的风险

1) 存托凭证和境外基础证券分别在境内和境外上市, 由于境内外市场的交易时差和交易制度的差异, 存托凭证的交易价格可能受到境外市场开盘价或者收盘价的影响, 从而出现大幅波动。

2) 存托凭证首次公开发行的价格可能高于境外基础证券的发行价格或者二级市场交易价格, 境外基础证券的交易价格也可能因基本面变化、第三方研究报告观点、境内外交易机制差异、异常交易情形、做空机制等出现较大波动, 影响境内存托凭证价格; 因境内外市场股权登记日、除权除息日的不同, 境内外证券在除权除息日也可能出现较大价格差异。

3) 在境内法律及监管政策允许的情况下, 境外基础证券可能转移至境内市场上市交易, 或者公司实施配股、非公开发行、回购等行为, 从而增加或者减少境内市场的存托凭证流通数量, 可能引起存托凭证交易价格波动。

4) 境内外市场证券停复牌制度存在差异, 存托凭证与境外基础证券可能出现在一个市场正常交易而在另一个市场实施停牌等现象。

## 14、投资北交所股票的风险



北交所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异。本基金投资北交所股票，将面临因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，可能的风险包括但不限于：

(1) 北交所上市公司经营风险北交所上市公司的资质可能较沪深证券交易上市公司的上市公司差。部分公司有规模小、对单一技术依赖度高、受技术更新迭代影响较大、对核心技术人员依赖度较高、客户集中度高、议价能力不强等特点，因此抗市场风险和行业风险的能力较弱，业务收入的波动也较大。

(2) 北交所股票股价波动较大的风险北交所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易市场的制度规则存在一定的差别，北交所股票新股上市首日无涨跌幅限制，其后涨跌幅限制比例为30%，可能导致北交所股票股价波动幅度较大。

(3) 北交所股票流动性较差的风险与沪深证券交易所上市公司相比，北交所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；北交所上市公司股权相对集中，市场整体流动性低于沪深证券交易所。基金所持的北交所股票变现时可能面临较高的冲击成本，也可能因所持北交所股票流动性枯竭，导致基金资产无法及时变现及其他相关流动性风险。

(4) 北交所上市公司退市风险根据北交所退市制度，上市公司退市情形较多，一旦所投资的北交所上市公司进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。

(5) 投资集中风险北交所上市的公司大部分为新兴产业公司，其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似，基金难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值波动。

(6) 转板风险基金所投资北交所上市的公司满足证券法和证监会规定的基本上市条件和符合交易所规定的具体上市条件可申请转板上市。交易所需审核并做出是否同意上市的决定。无论上市公司是否转板成功，均可能引起基金净值波动。

(7) 监管规则变化的风险北交所相关法律、行政法规、部门规章、规范性

文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致基金投资运作相应调整变化。

#### 15、法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

#### 16、其他风险

(1) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

(2) 基金管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

#### (二) 声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、本基金通过销售机构进行销售，但是，基金并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

# 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

## （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行，基金管理人应在决议生效后2日内在指定媒介公告。

## （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- （2）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

- (3) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估值和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月。

#### **(四) 清算费用**

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### **(五) 基金财产清算剩余资产的分配**

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### **(六) 基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### **(七) 基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 十九、基金合同内容摘要

### （一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法转让或申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- 9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

（2）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- 1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- 2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- 3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- 4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

7) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；

8) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 2、基金管理人简介

名称：上海东方证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路318号31层

法定代表人：潘鑫军

设立日期：2010年7月28日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可字[2010]518号

开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号：证监许可[2013]1131号

组织形式：有限责任公司

注册资本：3亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：（021）63325888

联系人：彭轶君

## 3、基金管理人的权利与义务

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

1) 依法募集资金；

2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

4) 销售基金份额；

5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

6) 依据《基金合同》及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人

违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；

9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

10) 依据《基金合同》及有关法律决定基金收益的分配方案；

11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等业务规则；

17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2) 办理基金备案手续；

3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保

证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7) 依法接受基金托管人的监督;

8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回的价格;

9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

10) 编制季度报告、中期报告和年度报告;

11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

12) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

14) 按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

18) 组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;



20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26) 建立并保存基金份额持有人名册；

27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### 4、基金托管人简况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：陈四清

成立时间：1984年1月1日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

注册资本：人民币34,932,123.46万元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号

#### 5、基金托管人的权利与义务

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利

包括但不限于：

1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

7) 法律法规、《基金合同》及中国证监会规定的其它权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

12) 建立并保存基金份额持有人名册；

13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

15) 按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## **(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份

额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

#### 1、召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止《基金合同》；
- 2) 更换基金管理人；
- 3) 更换基金托管人；
- 4) 转换基金运作方式；
- 5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 6) 变更基金类别；
- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略，法律法规和中国证监会另有规定的除外；
- 9) 变更基金份额持有人大会程序；
- 10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 11) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- 12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- 13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(2) 以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费；
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内、且在对现有基金份额持有人无实质性不利影响的前提下调低本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式；
- 4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的情形。

## 2、会议召集人及召集方式

(1) 除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

(3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

(4) 代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

(5) 代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30天，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、授权方式、送达时间和地点；
- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- 6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 7) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式及投票方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见提交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

### 4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式召开等法律法规或监管机构允许的其他方式，会议的召开方式由会议召集人确定。

(1) 现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- 1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》

和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不小于本基金在权益登记日基金总份额的50%（含50%）。

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于50%的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人参加，方可召开。

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的书面方式在表决截止日以前提交至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1) 会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在表决截止日前公布2次相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的50%（含50%）；

基金份额持有人持有的基金份额低于50%的，召集人可以在原公告的表决截止日的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人出具意见，方视为有效。

4) 上述第3)项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人，同时提交或经验证的持有基金份额的凭证、受托出具意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人可采用网络、电话、短信等其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方式上，本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

## 5、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### (2) 议事程序

#### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

#### 2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截



止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(2) 特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，提交符合会议通知中规定的确认投资人身份文件的表决视为有效出席的投资人，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 7、计票

### (1) 现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场

公布计票结果。

3)如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4)计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## (三) 基金合同变更和终止的事由、程序

### 1、《基金合同》的变更

(1) 变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大

会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

(2) 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行，基金管理人应在决议生效后2日内在指定媒介公告。

## 2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止的；

(2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

(3) 《基金合同》约定的其他情形；

(4) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## 3、基金财产的清算

(1) 基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(4) 基金财产清算程序：

1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

2) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

3) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

4) 对基金财产进行估值和变现；

5) 制作清算报告；

6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

- 7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- 9) 公布基金财产清算结果；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为6个月。

#### 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### 5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

### (四) 争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有决定，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》适用中华人民共和国法律并从其解释。

### (五) 基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅。

## 二十、托管协议的内容摘要

### （一）基金托管协议当事人

#### 1、基金管理人（或简称“管理人”）

名称：上海东方证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路318号31层

法定代表人：潘鑫军

成立时间：2010年7月28日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可字[2010]518号

开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号：证监许可[2013]1131号

注册资本：3亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：证券资产管理业务、公开募集证券投资基金管理业务

存续期间：持续经营

电话：（021）63325888

传真：（021）63326381

联系人：彭轶君

#### 2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）

法定代表人：陈四清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：郭明

成立时间：1984年1月1日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币34,932,123.46万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### 1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票及存托凭证（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金将基金资产的0%-95%投资于股票资产（含存托凭证）（其中投资于国内依法发行上市的股票、存托凭证的比例占基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-95%），权证投资比例不超过基金资产净值的3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

① 本基金投资组合中股票资产(含存托凭证)投资比例为基金资产的0%—95%；

② 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

③ 本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

④ 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算）不超过基金资产净值的10%；

⑤ 本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算），不超过该证券的10%；

本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的且由基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；

⑥ 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

⑦ 本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

⑧ 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；



⑨本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

⑩本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

⑪本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

⑫本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

⑬本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

⑭本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

⑮本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

⑯本基金每个交易日日终，持有国债期货或股指期货合约的，持有的买入国债期货和股指期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

⑰本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

⑱本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

⑲本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

⑳本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的

10%;

①本基金持有一家企业发行的单期中期票据，其市值不得超过本基金资产净值的10%;

②进入全国银行间同业市场的基金管理公司进行债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；进入全国银行间同业市场的基金管理公司进行债券回购的资金余额不得超过基金净资产的40%；

③本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

④本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

⑤本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

⑥本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制，基金管理人及时根据《信息披露办法》规定在指定媒介公告，且不需要经基金份额持有人大会审议。

### 3) 法规允许的基金投资比例调整期限

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准，但须与基金托管人协商一致后方可纳入基金托管人投资监督范围。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制，基金管理人及时根据《信息披露办法》规定在指定媒介公告，且不需要经基金份额持有人大会审议。

除③、⑬、⑭、⑮条外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法

律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前2个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

4)基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，基金的投资范围应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

(3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- 1) 承销证券；
- 2) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- 5) 向基金管理人、基金托管人出资；

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(4) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、

完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人履行披露义务。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

对于第三方数据不准确造成托管人无法及时发现管理人进行关联交易的，托管人不承担责任。

(5) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

1) 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须提前书面通知基金托管人，基金托管人于2个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

①如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，托管人有权报告中国证监会。

②基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，

基金托管人不承担责任。

③基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人在通知基金托管人后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核交易对手是否在名单内列明。

(6) 基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿。基金管理人在通知基金托管人后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核核心存款银行是否在名单内列明。

(7) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上

述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

5) 基金管理人投资沪港通、与沪港通类似机制的证券投资业务前，应与基金托管人就清算交收、核算估值及系统支持进行确认，确保双方均准备就绪方可投资。

2、基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额的基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

3、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人应当监督基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,必须在规定时间内答复基金托管人并改正,就基金托管人的疑义进行解释或举证,对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

### **(三) 基金管理人有关基金托管人的业务核查**

基金管理人有关基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时,基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正,基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正,并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有关义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有关重大违规行为,应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构,同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权,

或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### **（四）基金财产保管**

##### **1、基金财产保管的原则**

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

（5）对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

（6）除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### **2、募集资金的验证**

（1）基金设立募集期满，基金管理人应当聘请具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资并出具验资报告。基金管理人应不迟于基金成立当日向基金托管人提供注册会计师事务所正式出具的验资报告及管理公司出具的加盖公章的成立公告。

（2）基金成立，基金管理人应将全部募集期参与资金转入基金托管人指定的托管账户，并确保转入的资金与验资确认金额一致。在基金托管人确认本基金资产划入托管专户后，托管人正式承担托管职责。

（3）若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜，基金托管人应充分协助。



### 3、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，并根据基金管理人的符合本协议约定的有效指令办理资金收付。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

### 4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立本基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

### 5、债券托管账户的开立和管理

(1) 《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

(2) 基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券

市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### 6、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### 7、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后5个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门15年以上。

### **（五）基金资产净值计算和会计核算**

#### 1、基金资产净值的计算

##### （1）基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每个估值日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、

《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。

## 2、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值信息的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

## 3、基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成。

在《基金合同》生效后基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。基金管理人在每个季度结束之日起15个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后两个月内完成中期报告编制并公告；在会计年度结束后三个月内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在每个月度结束之日起5个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，对报告加盖公章后，以加密传真方式将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人在3个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在每个季度结束之日起7个工作日内完成季度报告，在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后7个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在会计年度半年终了后30日内完成中期报告，在中期报告完成当日，

将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在会计年度结束后 45 日内完成年度报告，在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

#### **(六) 基金份额持有人名册的保管**

登记机构负责编制基金份额持有人名册，基金管理人和基金托管人负责保管基金份额持有人名册。

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 20 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基

金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

### **（七）争议的解决方式**

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

### **（八）托管协议的变更与终止**

#### **1、托管协议的变更程序**

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

#### **2、基金托管协议终止的情形**

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规及中国证监会规定或《基金合同》规定的终止事项。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）基金份额持有人交易资料的寄送服务

本基金成立后每次交易结束后，投资者可在T+2个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单。

基金管理人在每季度结束后向定制纸质对账单且在季度内有交易或季度末最后一个交易日仍持有份额的投资者寄送季度对账单。

由于投资者提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过本公司网站，或拨打本公司客服热线查询、核对、变更预留联系方式。

### （二）定期定额投资计划

通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则和开放时间另行公告。

### （三）免费信息定制服务

基金客户可以通过拨打电话、发送邮件等方式定制每周基金净值、季度电子对账单等服务，基金管理人通过手机短信、E-MAIL定期为客户发送所定制的信息。

### （四）客户呼叫中心电话服务

客户呼叫中心自动语音系统提供7×24小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。

客户呼叫中心人工坐席提供每周5天、每天不少于8小时的坐席服务，投资者可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。

### （五）客户投诉受理服务

投资者可以通过各销售机构网点柜台、客户呼叫中心人工热线、书信、电子邮件等方式对基金管理人和销售网点所提供的服务以及基金管理人的政策规定进行投诉。

**(六) 基金管理人客户服务联络方式**

客户呼叫热线：4009200808，工作时间内可转人工坐席。

传真：（021）63326381

公司网址：[www.dfham.com](http://www.dfham.com)

电子信箱：[service@dfham.com](mailto:service@dfham.com)

（七）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系本公司。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 二十二、其他应披露事项

本基金信息披露的规定媒介为上海证券报、公司官网(网址:www.dfham.com)、中国证监会基金电子披露网站(网址: http://eid.csrc.gov.cn/fund)。以下为本基金 2021 年 3 月 9 日至 2022 年 3 月 3 日的信息披露文件:

序号	信息披露日	公告名称
1	2021 年 3 月 13 日	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告
2	2021 年 3 月 19 日	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新
3	2021 年 3 月 19 日	东方红沪港深灵活配置混合型基金招募说明书(更新)(2021 年第 1 号)
4	2021 年 3 月 31 日	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告
5	2021 年 4 月 8 日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加青岛银行股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告
6	2021 年 4 月 21 日	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告
7	2021 年 4 月 22 日	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告
8	2021 年 6 月 22 日	关于上海东方证券资产管理有限公司直销中心变更汇款账户的公告
9	2021 年 7 月 13 日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销平台开展费率优惠活动的公告
10	2021 年 7 月 21 日	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告
11	2021 年 8 月 4 日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告
12	2021 年 8 月 19 日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加北京创金启富基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告
13	2021 年 8 月 21 日	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告
14	2021 年 8 月 31 日	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告
15	2021 年 9 月 10 日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为代理销售机构的公告
16	2021 年 9 月 25 日	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变



		更的公告
17	2021年9月30日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告
18	2021年10月13日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金因港股通暂停交易而暂停开放的公告
19	2021年10月15日	关于部分基金在招商银行股份有限公司降低申购业务起点金额的公告
20	2021年10月27日	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金2021年第三季度报告
21	2021年11月3日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金在直销平台开展机构客户费率优惠活动的公告
22	2021年11月17日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所基金销售有限公司开通定期定额投资业务的公告
23	2021年11月19日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所股票的公告
24	2021年11月29日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销平台开展费率优惠活动的公告
25	2021年12月2日	上海东方证券资产管理有限公司关于设立北京分公司的公告
26	2021年12月10日	上海东方证券资产管理有限公司关于提醒直销平台投资者及时完善、更新身份资料信息的公告
27	2021年12月22日	上海东方证券资产管理有限公司关于公司网上直销平台暂停服务的公告
28	2021年12月28日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金2021年底及2022年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告
29	2021年12月29日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加北京度小满基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告
30	2022年1月1日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告
31	2022年1月6日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告
32	2022年1月7日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加南京银行股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告
33	2022年1月11日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金在交通银行股份有限公司不参与申购费率优惠活动的公告
34	2022年1月24日	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金2021年第四季度报告

35	2022年1月28日	上海东方证券资产管理有限公司关于自有资金投资旗下偏股型基金的公告
36	2022年2月11日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加广发证券股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告
37	2022年2月21日	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金调整申购及赎回数额限制的公告
38	2022年2月26日	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告

## 二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资者可在办公时间查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十四、备查文件

(一)中国证监会准予东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

(二)《东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)基金管理人业务资格批件、营业执照

(五)基金托管人业务资格批件、营业执照

(六)关于申请募集注册东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

(七)登记协议

(八)中国证监会要求的其他文件

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人处。投资者可在营业时间免费到存放地点查阅。

上海东方证券资产管理有限公司

二〇二二年三月十一日